

# СТРАТЕГИЯ «СЕМЬ САМУРАЕВ»

---

*Наверняка все помнят ставшую классикой историческую сагу Акиры Куросавы «Семь самураев» (1954). Сюжет данной картины вошел в золотой фонд кинематографии и был неоднократно воссоздан в ремейках. Вдохновленные образами героев Куросавы, мы постарались создать торговую стратегию, объединяющую акции. Подобно тому, как у каждого из семи самураев уникальный характер и собственный путь, у каждой из акций свое предназначение и уникальные характеристики. Прежде чем попасть в диверсифицированный портфель, каждая акция проходит многоуровневый кропотливый отбор, чтобы принести максимальную пользу стратегии.*

---



# ОТБОР АКТИВОВ В ПОРТФЕЛЬ

## ЛИКВИДНОСТЬ

*Только акции из индекса  
Московской биржи*

## ДИВЕРСИФИКАЦИЯ

*В портфель включаются акции из различных  
секторов российской экономики*

## ПОТЕНЦИАЛ РОСТА

*Только лучшие акции приобретаются в портфель.  
Аутсайдеры формируют в портфеле позиции  
с короткой продажей*

## НЕЙТРАЛЬНОСТЬ

*Динамика портфеля практически  
не зависит от динамики российского рынка*

---

Наш многолетний опыт в совокупности с детальным анализом показывает, что часто акции, наиболее удовлетворяющие требованию по ликвидности, включаются в фондовые индексы, такие, например, как индекс ММВБ. Поэтому для первоначального отбора бумаг в портфель мы используем именно акции, вошедшие в индекс ММВБ.

Диверсификация осуществляется на основе статистических оценок коэффициентов корреляции акций. Таким образом, только семь акций, отобранных способом, указанным выше, подобно семи самураям противостоят опасностям, турбулентности финансовых рынков и кризисам.

---

# РИСК-МЕНЕДЖМЕНТ

Стратегия включает в себя «оборону» в виде системы контроля за рисками, использующую как стандартные, так и уникальные инновационные подходы современного портфельного управления.

## РАЗМЕР ПОЗИЦИИ

*Зависит от волатильности рынка.  
Чем ниже волатильность,  
тем ближе расположен стоп-лосс*

## ФИЛЬТР ПО НАЛИЧИЮ ТРЕНДА

*Если у фундаментально дешевой акции  
отсутствует растущий тренд,  
то такой инструмент  
не включается в портфель*

## РЕБАЛАНСИРОВКА ПОРТФЕЛЯ

*Пересмотр структуры  
портфеля осуществляется  
ежемесячно*

---

Система контроля за рисками построена на том, что в результате исторического статистического тестирования определяется такой критический уровень снижения, который может свидетельствовать о наступлении:



Негативного  
тренда на рынке



Кризисных явлений  
на фондовых площадках



Глобальной  
нестабильности

# УНИКАЛЬНОСТЬ СТРАТЕГИИ



*Защищает  
капитал в случае  
кризиса*



*Слабо зависит от общей  
динамики рынка, новостного  
фона и слабопредсказуемых  
событий*



*Выбирает только лучшие  
среднесрочные идеи  
на российском рынке*

# ПОКАЗАТЕЛИ ДОХОДНОСТИ

ДИНАМИКА ДОХОДНОСТИ СТРАТЕГИИ «7 САМУРАЕВ»



# «ФИНАМ» — глобальный брокер и национальный лидер в сфере инвестиционных услуг



ВЫСОКИЙ РЕЙТИНГ  
НАДЕЖНОСТИ RAEX RUA



С 1994 ГОДА НА РЫНКЕ



БОЛЕЕ 235 000  
КЛИЕНТОВ



БОЛЕЕ 90 ОФИСОВ  
ПО ВСЕЙ СТРАНЕ



Лучшая брокерская компания  
для розничных инвесторов  
в рамках премии  
«Элита фондового рынка — 2018»



Лауреат премии  
«Финансовый Олимп — 2017»  
в двух категориях



«Лучший брокер»  
по версии журнала  
Financial One (2015–2016)



Гран-при премии  
«Финансовая элита России — 2018»



Гран-при премии  
«Финансовая элита России — 2017»



«Лучший брокер Восточной Европы»  
по версии IAIR Awards 2014

...и еще более 50 наград!

# КОНТАКТЫ